

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	21
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	21
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	22
6.1 资产负债表	22
6.2 利润表	23
6.3 净资产变动表	24
6.4 报表附注	26
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	68
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	73
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500
基金主代码	517080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 01 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	185,166,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 02 月 22 日

注：扩位证券简称：沪港深 500ETF 汇添富。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	(010) 66105798
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告置备地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	12,028,785.18
本期利润	269,580.31
加权平均基金份额本期利润	0.0013
本期加权平均净值利润率	0.12%
本期基金份额净值增长率	-0.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)

期末可供分配利润	-14,408,309.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0778
期末基金资产净值	185,905,067.69
期末基金份额净值	1.0040
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.06%	1.10%	3.40%	1.10%	0.66%	0.00%
过去六个月	-0.94%	1.08%	-1.67%	1.08%	0.73%	0.00%
过去一年	13.72%	0.98%	11.89%	0.98%	1.83%	0.00%
过去三年	34.40%	1.09%	25.55%	1.11%	8.85%	-0.02%
过去五年	4.64%	1.13%	-8.56%	1.15%	13.20%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.40%	1.13%	-9.70%	1.15%	10.10%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富中证沪港深500ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021年02月01日）起6个月，建仓期结束各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富基金销售（上海）有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2026 上半年，汇添富基金新成立 30 只公开募集证券投资基金。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 421 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
董瑾	本基金的基金经理	2021 年 02 月 01 日	—	17	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基

					金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

					2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。 2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。 2019 年 12 月 31 日至 2023 年 8 月 29 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。 2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券
--	--	--	--	--	---

					投资基金的基金经理。 2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资
--	--	--	--	--	---

					基金的基金 经理。2022 年 5 月 23 日 至今任汇添 富中证电池 主题交易型 开放式指数 证券投资基金 发起式联接基金的基金 经理。 2022 年 6 月 13 日至今任 汇添富中证 国企一带一 路交易型开 放式指数证 券投资基金 的基金经 理。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇 添富中证上 海环交所碳 中和交易型 开放式指数 证券投资基金 的基金经 理。2022 年 12 月 29 日 至今任汇添 富中证全指 医疗器械交 易型开放式 指数证券投 资基金发起 式联接基金 的基金经 理。2023 年 1 月 16 日至 今任汇添富 中证细分有 色金属产业
--	--	--	--	--	--

					主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证
--	--	--	--	--	--

					券投资基金 联接基金 （LOF）的基 金经理。 2023 年 8 月 23 日至 2024 年 10 月 26 日任汇添富 中证沪港深 消费龙头指 数型发起式 证券投资基金 的基金经 理。2023 年 9 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添 富中证 2000 交易型开放 式指数证券 投资基金的 基金经理。 2024 年 4 月 24 日至 2025 年 8 月 18 日 任汇添富中 证港股通高 股息投资交 易型开放式 指数证券投 资基金的基 金经理。 2024 年 6 月 12 日至 2025 年 8 月 18 日 任汇添富中 证港股通高 股息投资交 易型开放式 指数证券投 资基金联接 基金（LOF） 的基金经 理。2025 年
--	--	--	--	--	--

					3 月 21 日至 今任汇添富 中证细分有 色金属产业 主题交易型 开放式指数 证券投资基金 发起式联接 基金的基金 经理。 2025 年 5 月 22 日至今任 汇添富中证 港股通汽车 产业主题交 易型开放式 指数证券投资 基金的基金 经理。 2025 年 7 月 2 日至今任 汇添富沪深 300 交易型 开放式指数 证券投资基金 发起式联接 基金的基金 经理。 2026 年 3 月 25 日至今任 汇添富中证 全指电力公 用事业交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2026 年 4 月 9 日 至今任汇添 富中证港股 通医疗主题 交易型开放 式指数证券 投资基金的
--	--	--	--	--	--

					基金经理。 2026 年 4 月 22 日至今任汇添富中证家电龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
李雅楠	本基金的基金经理	2026 年 06 月 29 日	-	6	国籍：中国。学历：清华大学应用统计硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2021 年 6 月至 2023 年 10 月在兴银理财有限责任公司工作，2023 年 10 月至 2026 年 1 月在平安理财有限责任公司工作。2026 年 1 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2026 年 6 月 29 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 29 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型

					开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 29 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 6 月 29 日至今任汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2026 年 6 月 29 日至今任汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

本基金的基金经理董瑾女士于 2025 年 9 月 29 日起休产假,自 2026 年 5 月 6 日起恢复履行本基金的基金经理职务,在此期间本基金由晏阳先生代为履行基金经理职责。(详情请见基金管理人 2025 年 9 月 26 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于代为履行基金经理职责的公告》,以及 2026 年 5 月 6 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于基金经理恢复

履行职务的公告》)。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，力争在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易

数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外,为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突,本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面,对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年,国内宏观经济总量运行平稳,GDP 增速基本符合年度预期增长目标。全球宏观环境迎来多重变局:海外基本面新旧动能分化加剧,发达经济体复苏不一;美伊冲突等地缘政治升温,扰动市场风险偏好,加剧全球增长和通胀前景的不确定性。面对复杂外部,中国经济总体保持韧性,名义增长由负转正,通缩压力缓解,出口凭借产业链优势持续提升竞争力,同时以人工智能为代表的新经济引领地位进一步夯实。国内经济动能切换,结构分化显著。外需受益于全球补库与竞争力强化而持续向好,内需则因居民收入预期偏弱及地产修复缓慢而相对不足。高技术制造、出口链和新兴产业投资景气度再超预期,展现出强弹性,而建筑业、传统制造业部门及居民部门资产负债表仍处于弱复苏阶段。

资本市场方面,上半年国内权益市场整体震荡上行,但节奏波动加大,行情呈现 K 型分化。全球科技产业链在 AI 与半导体周期共振下,供需关系趋紧,盈利预期处于较强状态。作为宏观经济结构背离的映射,科技与高端制造行业强势领跑,地产、消费等传统板块则持续承压。风格维度上,上半年成长风格相对价值风格显著占优,资金向高景气赛道高度集中。

报告期内,本基金遵循被动指数投资原则,采用完全复制法,实现了对标的指数的良好跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-0.94%,同期业绩比较基准收益率为-1.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济总量稳中向好、结构分化的趋势有望延续。在外需韧性与新动能增强支撑下,内需渐进修复,分化格局短期难改。新经济对增长的拉动作用日益增强,特别是 AI 革命正激发从算力基础设施到终端应用的大规模资本开支,有望带动全要素生产率再次跃升,为长期增长注入动力。同时,传统能源供给脆弱性凸显,进一步强化了电力和新能源的战略安全价值,将推动相关产业链在盈利、产能和出口份额上实现快速扩张。宏观政策层面,预计将在年度既定资源框架内强化逆周期调节,重点加快专项债、财政支出等存量政策落地,以巩固经济回升向好态势。

映射到资本市场，下半年国内权益资产仍具备较好配置价值。基本面来看，A 股即将步入库存周期与产能周期的共振向上阶段，当前工业企业库存已处低位，产能周期开启，盈利修复动能增强。TMT 与先进制造是此前盈利恢复的核心引擎，AI 算力、半导体等景气有望延续。叠加通胀温和回升，中下游企业利润率改善可期。估值维度，主要宽基指数风险溢价处于历史合理分位，股债性价比凸显。流动性与资金面维度，国内货币政策维持呵护基调，资本市场制度完善与长线资金入市机制加速，叠加海外流动性拐点渐近，市场增量资金前景可期。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法严格控制偏离，实现对标的指数的紧密跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,947,986.05	9,509,078.84
结算备付金		2,341,854.62	5,295,497.76
存出保证金		1,033,878.35	1,320,206.20
交易性金融资产	6.4.7.2	173,428,802.67	252,686,298.83
其中：股票投资		173,428,802.67	252,686,298.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		296,350.10	234,815.39
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		186,048,871.79	269,045,897.02
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		14.92	50.50
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,737.83	34,498.49
应付托管费		7,912.59	11,499.48
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,876.70	84,872.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	89,262.06	179,599.34
负债合计		143,804.10	310,520.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	185,166,000.00	265,166,000.00
未分配利润	6.4.7.9	739,067.69	3,569,376.23
净资产合计		185,905,067.69	268,735,376.23
负债和净资产总计		186,048,871.79	269,045,897.02

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0040 元，基金份额总额 185,166,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30
-----	-----	--	---

		日	日
一、营业总收入		575,815.15	38,427,597.03
1. 利息收入		42,338.33	86,908.93
其中：存款利息收入	6.4.7.10	42,338.33	86,908.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,998,879.96	-4,949,043.75
其中：股票投资收益	6.4.7.11	9,151,669.34	-9,967,678.61
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	3,922.18
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	756,122.19	-433,874.21
股利收益	6.4.7.17	2,091,088.43	5,448,586.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-11,759,204.87	43,559,941.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	293,801.73	-270,209.62
减：二、营业总支出		306,234.84	488,677.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	163,473.40	299,713.28
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,491.09	99,904.44
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		2,723.70	-
8. 其他费用	6.4.7.21	85,546.65	89,060.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		269,580.31	37,938,919.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		269,580.31	37,938,919.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		269,580.31	37,938,919.17

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	265,166,000.00	3,569,376.23	268,735,376.23
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	265,166,000.00	3,569,376.23	268,735,376.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-80,000,000.00	-2,830,308.54	-82,830,308.54
（一）、综合收益总额	-	269,580.31	269,580.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-80,000,000.00	-3,099,888.85	-83,099,888.85
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-80,000,000.00	-3,099,888.85	-83,099,888.85
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	185,166,000.00	739,067.69	185,905,067.69
项目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	541,166,000.00	-104,212,202.84	436,953,797.16
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	541,166,000.00	-104,212,202.84	436,953,797.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-108,000,000.00	53,506,738.66	-54,493,261.34
（一）、综合收益总额	-	37,938,919.17	37,938,919.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-108,000,000.00	15,567,819.49	-92,432,180.51
其中：1. 基金申购款	20,000,000.00	-3,849,743.02	16,150,256.98
2. 基金赎回款	-128,000,000.00	19,417,562.51	-108,582,437.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	433,166,000.00	-50,705,464.18	382,460,535.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2020〕3528 号文《关于准予汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2021 年 2 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 1,089,166,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2021）验字第 60466941_B19 号验资报告予以验证。本

基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号<会计报表附注的编制及披露>》,中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定,自2023年8月28日起,证券交易印花税实施减半征收。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年

第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税。金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得

税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	8,947,986.05
等于：本金	8,947,095.77
加：应计利息	890.28
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,947,986.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		160,326,400.81	-	173,428,802.67	13,102,401.86
贵金属投资-金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		160,326,400.81	-	173,428,802.67	13,102,401.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投 资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投 资）	-	-	-	-
权益衍生工具	8,316,060.00	-	-	-

（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	8,316,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,316,060.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2612	IF2612	6	8,570,520.00	254,460.00
合计				254,460.00
减：可抵销期货暂收款				254,460.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,439.20
其中：交易所市场	7,439.20
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	22,315.49
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	89,262.06

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	265,166,000.00	265,166,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-80,000,000.00	-80,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	185,166,000.00	185,166,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-34,985,406.19	38,554,782.42	3,569,376.23
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-34,985,406.19	38,554,782.42	3,569,376.23
本期利润	12,028,785.18	-11,759,204.87	269,580.31
本期基金份额交易产生的变动数	8,548,311.94	-11,648,200.79	-3,099,888.85
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	8,548,311.94	-11,648,200.79	-3,099,888.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,408,309.07	15,147,376.76	739,067.69

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	15,588.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,728.62
其他	20.93
合计	42,338.33

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,165,564.07
股票投资收益——赎回差价收入	1,986,105.27
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	9,151,669.34

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	66,203,043.57
减：卖出股票成本总额	58,950,867.04
减：交易费用	86,612.46
买卖股票差价收入	7,165,564.07

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	83,099,888.85
减：现金支付赎回款总额	56,061,980.68
减：赎回股票成本总额	25,051,802.90
减：交易费用	—
赎回差价收入	1,986,105.27

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
股指期货投资收益	756,122.19
外汇期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,091,088.43
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,091,088.43

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,776,064.87
——股票投资	-11,776,064.87
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	16,860.00
——权证投资	-
——期货投资	16,860.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-11,759,204.87

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	293,801.73
其他	-
合计	293,801.73

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	127.00
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	3,596.79
合计	85,546.65

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
----	---	--

当期发生的基金应支付的管理费	163,473.40	299,713.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	45,416.39	83,286.20
应支付基金管理人的净管理费	118,057.01	216,427.08

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	54,491.09	99,904.44

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	8,947,986.05	15,588.78	22,219,977.87	43,836.63

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 18,124.00 股，占本基金净值比例为 0.09%。持有基金托管人工商银行发行的股票 444,900.00 股，占本基金净值比例为 1.43%。（于上期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 41,624.00 股，占本基金净值比例为 0.11%。持有基金托管人工商银行发行的股票 1,042,600.00 股，占本基金净值比例为 1.69%。）

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公

告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	744	152,109.50	619,008.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发

行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,947,986.05	-	-	-	-	-	8,947,986.05
结算备付金	2,341,854.62	-	-	-	-	-	2,341,854.62
存出保证金	5,415.95	-	-	-	-	1,028,462.40	1,033,878.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	173,428,802.67	173,428,802.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	296,350.10	296,350.10
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	11,295,256.62	-	-	-	-	174,753,615.17	186,048,871.79
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	14.92	14.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,737.83	23,737.83
应付托管费	-	-	-	-	-	7,912.59	7,912.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	22,876.70	22,876.70
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	89,262.06	89,262.06
负债总计	-	-	-	-	-	143,804.10	143,804.10
利率敏感度缺口	11,295,256.62	-	-	-	-	174,609,811.07	185,905,067.69
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	9,509,078.84	-	-	-	-	-	9,509,078.84
结算备付金	5,295,497.76	-	-	-	-	-	5,295,497.76

存出保证金	10,324.60	-	-	-	-	1,309,881.60	1,320,206.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	252,686,298.83	252,686,298.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	234,815.39	234,815.39
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,814,901.20	-	-	-	-	254,230,995.82	269,045,897.02
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	50.50	50.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,498.49	34,498.49
应付托管费	-	-	-	-	-	11,499.48	11,499.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	84,872.98	84,872.98

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	179,599.34	179,599.34
负债总计	-	-	-	-	-	310,520.79	310,520.79
利率敏感度缺口	14,814,901.20	-	-	-	-	253,920,475.03	268,735,376.23

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	67,933,561.41	-	67,933,561.41
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	296,350.10	-	296,350.10
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	68,229,911.51	-	68,229,911.51
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	68,229,911.51	-	68,229,911.51
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	115,241,404.41	-	115,241,404.41
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	234,815.39	-	234,815.39
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	115,476,219.80	-	115,476,219.80
以外币计价的负债				

短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	115,476,219.80	-	115,476,219.80

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	3,411,495.58	5,773,810.99
	港币相对人民币贬值 5%	-3,411,495.58	-5,773,810.99

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	173,428,802.67	93.29	252,686,298.83	94.03
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	173,428,802.67	93.29	252,686,298.83	94.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	中证沪港深 500 指数 上涨 5%	9,306,967.72	13,241,388.92
	中证沪港深 500 指数 下跌 5%	-9,306,967.72	-13,241,388.92

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	172,809,794.67
第二层次	619,008.00
第三层次	-
合计	173,428,802.67

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	173,428,802.67	93.22
	其中：股票	173,428,802.67	93.22
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	11,289,840.67	6.07
8	其他各项资产	1,330,228.45	0.71
9	合计	186,048,871.79	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 67,933,561.41 元，占期末净值比例为 36.54%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	561,724.60	0.30
B	采矿业	4,681,899.35	2.52
C	制造业	68,470,855.87	36.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,488,239.00	1.34
E	建筑业	1,115,832.20	0.60
F	批发和零售业	164,420.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	2,395,299.00	1.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,809,306.79	3.12
J	金融业	17,567,904.45	9.45
K	房地产业	437,937.00	0.24
L	租赁和商务服务业	443,647.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	1,168,507.10	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	133,109.90	0.07

R	文化、体育和娱乐业	56,559.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	105,495,241.26	56.75

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	2,650,714.72	1.43
15 原材料	1,097,803.77	0.59
20 工业	3,039,486.39	1.63
25 可选消费	11,580,041.01	6.23
30 日常消费	1,265,407.87	0.68
35 医疗保健	2,685,860.61	1.44
40 金融	25,185,999.68	13.55
45 信息技术	4,625,176.40	2.49
50 电信服务	11,791,810.02	6.34
55 公用事业	1,656,564.58	0.89
60 房地产	2,354,696.36	1.27
合计	67,933,561.41	36.54

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	24,500	9,145,918.36	4.92
2	00005	汇丰控股	65,600	8,426,880.55	4.53
3	09988	阿里巴巴—	73,500	5,927,397.7	3.19

		W		6	
4	300308	中际旭创	3,860	4,902,200.0 0	2.64
5	300750	宁德时代	9,240	3,631,412.4 0	1.95
5	03750	宁德时代	400	243,888.84	0.13
6	00939	建设银行	461,000	3,231,240.5 1	1.74
6	601939	建设银行	29,300	282,159.00	0.15
7	601318	中国平安	36,900	1,761,606.0 0	0.95
7	02318	中国平安	29,000	1,285,844.8 5	0.69
8	300502	新易盛	4,640	2,816,480.0 0	1.52
9	01398	工商银行	333,000	1,859,730.5 7	1.00
9	601398	工商银行	111,900	791,133.00	0.43
10	00981	中芯国际	18,000	1,397,670.6 6	0.75
10	688981	中芯国际	6,897	1,095,381.5 4	0.59
11	600519	贵州茅台	2,100	2,489,529.0 0	1.34
12	01299	友邦保险	39,800	2,469,904.3 2	1.33
13	600036	招商银行	42,900	1,522,950.0 0	0.82
13	03968	招商银行	17,500	682,767.16	0.37
14	601899	紫金矿业	57,000	1,432,980.0 0	0.77
14	02899	紫金矿业	24,000	571,158.48	0.31
15	688256	寒武纪科技	1,143	1,823,713.6 5	0.98
16	00941	中国移动	23,500	1,554,291.9 4	0.84
16	600941	中国移动	3,100	267,003.00	0.14
17	603986	兆易创新	2,180	1,776,700.0 0	0.96
18	01211	比亚迪股份	14,100	887,262.91	0.48
18	002594	比亚迪	9,500	757,150.00	0.41
19	00388	香港交易所	4,900	1,544,889.8 9	0.83

20	000333	美的集团	16,882	1,275,097.46	0.69
20	00300	美的集团	2,400	172,181.35	0.09
21	03690	美团-W	23,720	1,411,237.41	0.76
22	00883	中国海洋石油	67,000	1,182,478.71	0.64
22	600938	中国海油	8,300	225,345.00	0.12
23	03988	中国银行	255,000	1,105,186.45	0.59
23	601988	中国银行	49,500	283,140.00	0.15
24	01810	小米集团-W	69,200	1,300,643.20	0.70
25	688008	澜起科技	4,058	1,257,574.20	0.68
26	688012	中微半导体设备	2,669	1,250,426.50	0.67
27	002371	北方华创	1,410	1,247,229.60	0.67
28	002475	立讯精密	17,700	1,246,080.00	0.67
29	02888	渣打集团	6,750	1,240,549.97	0.67
30	688041	海光信息	3,335	1,234,950.50	0.66
31	002384	东山精密	4,400	1,154,340.00	0.62
32	600030	中信证券	33,775	970,355.75	0.52
32	06030	中信证券	7,475	176,983.13	0.10
33	601288	农业银行	99,400	603,358.00	0.32
33	01288	农业银行	117,000	542,652.67	0.29
34	600900	长江电力	42,400	1,122,328.00	0.60
35	000725	京东方 A	125,800	1,091,944.00	0.59
36	603259	药明康德	8,560	1,065,805.60	0.57
37	601138	工业富联	13,800	995,670.00	0.54
38	601328	交通银行	92,300	593,489.00	0.32
38	03328	交通银行	66,000	386,365.78	0.21
39	00857	中国石油股份	80,000	589,224.32	0.32
39	601857	中国石油	44,800	388,864.00	0.21

40	601166	兴业银行	58,600	970,416.00	0.52
41	300059	东方财富	43,654	889,668.52	0.48
42	600183	生益科技	5,100	884,340.00	0.48
43	300394	天孚通信	2,904	878,982.72	0.47
44	02628	中国人寿	28,000	648,355.20	0.35
44	601628	中国人寿	5,800	205,030.00	0.11
45	01088	中国神华	12,500	435,577.83	0.23
45	601088	中国神华	9,600	374,784.00	0.20
46	600276	恒瑞医药	15,400	801,416.00	0.43
47	300274	阳光电源	5,020	798,280.40	0.43
48	300408	三环集团	4,700	784,430.00	0.42
49	600487	亨通光电	6,800	743,512.00	0.40
50	002463	沪电股份	4,700	718,160.00	0.39
51	601211	国泰海通	39,162	712,748.40	0.38
52	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	0.37
53	688525	佰维存储	1,400	692,622.00	0.37
54	00669	创科实业	6,000	674,863.35	0.36
55	06160	百济神州	4,400	651,204.05	0.35
56	301308	江波龙	900	633,420.00	0.34
57	000988	华工科技	3,400	627,674.00	0.34
58	688072	拓荆科技	744	619,008.00	0.33
59	600176	中国巨石	8,336	607,527.68	0.33
60	00992	联想集团	30,000	599,820.63	0.32
61	02388	中银香港	16,000	588,946.38	0.32
62	00016	新鸿基地产	6,000	585,228.99	0.31
63	601601	中国太保	11,800	336,536.00	0.18
63	02601	中国太保	10,600	247,474.21	0.13
64	000651	格力电器	15,400	577,500.00	0.31
65	600522	中天科技	9,500	576,460.00	0.31
66	01347	华虹宏力	3,000	560,735.88	0.30
67	688521	芯原微电子	1,477	548,173.78	0.29
68	600919	江苏银行	50,800	547,624.00	0.29
69	603019	中科曙光	5,100	546,873.00	0.29
70	00001	长和	9,500	546,643.66	0.29
71	00386	中国石油化工股份	92,000	319,626.40	0.17
71	600028	中国石化	50,400	224,784.00	0.12
72	603993	洛阳钼业	30,300	531,765.00	0.29
73	600150	中国船舶	15,548	525,366.92	0.28
74	600887	伊利股份	21,900	524,724.00	0.28
75	600584	长电科技	5,000	517,750.00	0.28
76	000338	潍柴动力	18,700	509,575.00	0.27
77	000858	五 粮 液	6,599	488,326.00	0.26

78	01801	信达生物	7,000	483,956.06	0.26
79	601728	中国电信	53,700	278,703.00	0.15
79	00728	中国电信	52,000	192,852.84	0.10
80	02269	药明生物	15,500	465,803.37	0.25
81	601816	京沪高铁	101,600	460,248.00	0.25
82	600690	海尔智家	13,000	265,330.00	0.14
82	06690	海尔智家	11,000	190,889.92	0.10
83	00002	中电控股	7,000	445,045.02	0.24
84	600309	万华化学	6,400	437,824.00	0.24
85	002415	海康威视	12,700	434,340.00	0.23
86	002916	深南电路	940	430,426.00	0.23
87	300124	汇川技术	6,450	427,828.50	0.23
88	600111	北方稀土	8,800	422,840.00	0.23
89	000100	TCL 科技	72,070	419,447.40	0.23
90	601688	华泰证券	20,200	416,524.00	0.22
91	01024	快手-W	11,500	415,514.32	0.22
92	000063	中兴通讯	11,100	401,709.00	0.22
93	600000	浦发银行	46,100	396,921.00	0.21
94	600089	特变电工	17,490	393,525.00	0.21
95	09992	泡泡玛特	2,800	376,221.12	0.20
96	300433	蓝思科技	6,800	364,888.00	0.20
97	002028	思源电气	2,100	363,300.00	0.20
98	09987	百胜中国	1,300	360,865.15	0.19
99	600031	三一重工	20,500	354,240.00	0.19
100	01109	华润置地	13,500	351,762.75	0.19
101	00175	吉利汽车	24,000	351,450.07	0.19
102	300223	北京君正	1,400	348,460.00	0.19
103	02328	中国财险	28,000	348,253.81	0.19
104	300014	亿纬锂能	5,300	344,659.00	0.19
105	002142	宁波银行	11,400	338,466.00	0.18
106	000001	平安银行	33,600	337,680.00	0.18
107	002050	三花智控	7,700	337,491.00	0.18
108	002714	牧原股份	9,540	333,804.60	0.18
109	000792	盐湖股份	10,900	329,071.00	0.18
110	00998	中信银行	34,000	196,379.16	0.11
110	601998	中信银行	18,400	127,512.00	0.07
111	600549	厦门钨业	3,800	323,760.00	0.17
112	02020	安踏体育	5,200	320,894.48	0.17
113	600406	国电南瑞	13,962	319,031.70	0.17
114	002156	通富微电	4,200	318,654.00	0.17
115	601668	中国建筑	71,500	310,310.00	0.17
116	601658	邮储银行	38,200	188,326.00	0.10
116	01658	邮储银行	30,000	119,078.21	0.06

117	002353	杰瑞股份	2,000	305,000.00	0.16
118	601229	上海银行	34,500	299,460.00	0.16
119	00006	电能实业	6,000	297,565.23	0.16
120	000657	中钨高新	3,100	296,732.00	0.16
121	601919	中远海控	21,800	289,068.00	0.16
122	01113	长实集团	7,500	287,794.04	0.15
123	002602	世纪华通	20,400	287,640.00	0.15
124	600660	福耀玻璃	5,600	282,464.00	0.15
125	600016	民生银行	85,800	276,276.00	0.15
126	601012	隆基绿能	21,031	275,926.72	0.15
127	601225	陕西煤业	13,500	274,725.00	0.15
128	603501	豪威集团	2,895	274,590.75	0.15
129	600999	招商证券	12,900	272,190.00	0.15
130	300760	迈瑞医疗	2,000	271,660.00	0.15
131	002230	科大讯飞	6,600	269,544.00	0.14
132	688777	中控技术	2,271	266,842.50	0.14
133	09633	农夫山泉	7,600	261,530.83	0.14
134	09868	小鹏集团— W	5,900	259,553.14	0.14
135	002352	顺丰控股	8,300	259,458.00	0.14
136	603799	华友钴业	5,350	258,191.00	0.14
137	02423	贝壳—W	7,900	257,719.63	0.14
138	002709	天赐材料	5,000	257,150.00	0.14
139	601985	中国核电	28,400	256,452.00	0.14
140	300033	同花顺	1,060	255,460.00	0.14
141	600926	杭州银行	17,600	254,320.00	0.14
142	01378	中国宏桥	14,500	252,635.14	0.14
143	002460	赣锋锂业	3,860	252,444.00	0.14
144	601169	北京银行	51,300	251,370.00	0.14
145	600160	巨化股份	4,700	249,147.00	0.13
146	000977	浪潮信息	3,500	245,000.00	0.13
147	00288	万洲国际	34,000	244,809.50	0.13
148	002938	鹏鼎控股	2,300	242,374.00	0.13
149	00003	香港中华煤 气	42,700	241,066.05	0.13
150	000776	广发证券	10,300	241,020.00	0.13
151	01171	兖矿能源	12,900	123,807.46	0.07
151	600188	兖矿能源	6,255	111,151.35	0.06
152	300442	润泽科技	2,800	232,596.00	0.13
153	02015	理想汽车— W	5,800	232,132.15	0.12
154	00027	银河娱乐	9,000	229,974.67	0.12
155	002202	金风科技	9,600	229,440.00	0.12

156	09926	康方生物	3,000	229,427.48	0.12
157	000425	徐工机械	28,300	228,947.00	0.12
158	300661	圣邦股份	1,593	228,563.64	0.12
159	000938	紫光股份	7,900	227,994.00	0.12
160	300498	温氏股份	18,500	227,920.00	0.12
161	688126	上海硅产业集团	5,639	224,939.71	0.12
162	601600	中国铝业	27,300	224,406.00	0.12
163	688082	盛美上海半导体	517	223,344.00	0.12
164	002600	领益智造	12,700	220,218.00	0.12
165	601766	中国中车	42,100	218,920.00	0.12
166	600460	士兰微	4,000	218,640.00	0.12
167	01519	极兔速递—W	30,000	217,832.34	0.12
168	688249	晶合集成	3,667	216,463.01	0.12
169	600050	中国联通	54,100	216,400.00	0.12
170	02057	中通快递—W	1,450	216,112.61	0.12
171	002466	天齐锂业	3,500	214,620.00	0.12
172	601009	南京银行	21,400	211,646.00	0.11
173	002837	英维克	2,600	206,856.00	0.11
174	03692	翰森制药	8,000	205,811.61	0.11
175	601100	恒立液压	1,900	204,364.00	0.11
176	002049	紫光国微	2,300	204,125.00	0.11
177	002179	中航光电	4,382	202,448.40	0.11
178	00066	港铁公司	7,500	198,680.81	0.11
179	002080	中材科技	2,200	198,000.00	0.11
180	603288	海天味业	5,895	195,478.20	0.11
181	605117	德业股份	1,841	195,477.38	0.11
182	601872	招商轮船	11,100	195,027.00	0.10
183	000568	泸州老窖	2,500	193,800.00	0.10
184	002241	歌尔股份	8,600	193,758.00	0.10
185	00267	中信股份	21,000	193,521.63	0.10
186	01308	海丰国际	7,000	190,785.69	0.10
187	601006	大秦铁路	41,200	189,932.00	0.10
188	600809	山西汾酒	1,720	188,116.40	0.10
189	688396	华润微电子	1,900	185,345.00	0.10
190	601818	光大银行	64,100	185,249.00	0.10
191	002625	光启技术	6,100	184,952.00	0.10
192	600905	三峡能源	49,400	183,274.00	0.10
193	688271	联影医疗	1,809	183,125.07	0.10
194	600489	中金黄金	10,100	182,305.00	0.10

195	000408	藏格矿业	2,600	180,232.00	0.10
196	601888	中国中免	3,300	177,243.00	0.10
197	000630	铜陵有色	27,800	176,808.00	0.10
198	600893	航发动力	4,600	176,364.00	0.09
199	688111	金山办公	824	175,553.20	0.09
200	600010	宝钢股份	78,200	174,386.00	0.09
201	00688	中国海外发展	16,500	172,832.76	0.09
202	600118	中国卫星	2,100	172,305.00	0.09
203	601127	赛力斯	2,800	171,500.00	0.09
204	600958	东方证券	18,124	171,090.56	0.09
205	002027	分众传媒	35,100	169,884.00	0.09
206	01093	石药集团	28,000	169,506.22	0.09
207	601689	拓普集团	2,975	167,849.50	0.09
208	02319	蒙牛乳业	12,000	167,699.63	0.09
209	601336	新华保险	2,800	167,048.00	0.09
210	000426	兴业银锡	5,000	164,800.00	0.09
211	01177	中国生物制药	43,000	164,703.14	0.09
212	600019	宝钢股份	30,200	163,986.00	0.09
213	600760	中航沈飞	3,888	159,796.80	0.09
214	688183	生益电子	1,200	158,880.00	0.09
215	601168	西部矿业	5,800	157,412.00	0.08
216	000807	云铝股份	7,100	157,194.00	0.08
217	603296	华勤技术	2,100	155,967.00	0.08
218	600362	江西铜业	3,600	155,880.00	0.08
219	601838	成都银行	8,800	155,760.00	0.08
220	01038	长江基建集团	3,000	155,557.31	0.08
221	600104	上汽集团	15,900	155,184.00	0.08
222	600989	宝丰能源	7,600	154,508.00	0.08
223	002001	新 和 成	5,400	153,468.00	0.08
224	601727	上海电气	21,900	153,300.00	0.08
225	600875	东方电气	5,300	152,481.00	0.08
226	300450	先导智能	3,740	152,292.80	0.08
227	603893	瑞芯微	800	150,688.00	0.08
228	00020	商汤-W	129,000	150,137.55	0.08
229	601825	沪农商行	20,000	149,800.00	0.08
230	600885	宏发股份	4,324	149,134.76	0.08
231	02382	舜宇光学科技	2,800	148,348.34	0.08
232	601390	中国中铁	35,300	147,201.00	0.08
233	002422	科伦药业	3,800	146,376.00	0.08

234	601995	中金公司	4,000	144,600.00	0.08
235	601377	兴业证券	23,900	144,356.00	0.08
236	600795	国电电力	30,900	144,303.00	0.08
237	600547	山东黄金	6,200	143,158.00	0.08
238	000538	云南白药	3,020	143,057.40	0.08
239	00083	信和置业	16,000	142,859.10	0.08
240	600418	江淮汽车	5,500	142,065.00	0.08
241	09626	哔哩哔哩— W	1,240	141,841.16	0.08
242	600015	华夏银行	22,100	141,219.00	0.08
243	06618	京东健康	4,950	141,189.75	0.08
244	600585	海螺水泥	8,300	140,685.00	0.08
245	002812	恩捷股份	2,100	140,511.00	0.08
246	601669	中国电建	29,800	140,060.00	0.08
247	002648	卫星化学	5,898	138,544.02	0.07
248	000166	申万宏源	31,200	137,280.00	0.07
249	601916	浙商银行	52,080	136,970.40	0.07
250	00788	中国铁塔	17,900	136,969.47	0.07
251	09660	地平线机器人— W	38,400	136,077.47	0.07
252	300782	卓胜微	1,236	135,440.88	0.07
253	600096	云天化	4,400	133,760.00	0.07
254	300015	爱尔眼科	16,115	133,109.90	0.07
255	601698	中国卫通	4,400	133,100.00	0.07
256	688047	龙芯中科	860	133,016.20	0.07
257	300316	晶盛机电	2,200	132,880.00	0.07
258	601066	中信建投	4,500	130,815.00	0.07
259	603228	景旺电子	1,800	130,338.00	0.07
260	01997	九龙仓置业	7,000	129,987.19	0.07
261	02018	瑞声科技	3,500	129,804.80	0.07
262	600346	恒力石化	7,300	129,283.00	0.07
263	00012	恒基地产	6,000	129,240.24	0.07
264	601868	中国能建	48,300	128,961.00	0.07
265	600482	中国动力	3,900	127,920.00	0.07
266	00762	中国联通	24,000	127,364.17	0.07
267	002558	巨人网络	4,600	126,776.00	0.07
268	600580	卧龙电驱	3,800	125,780.00	0.07
269	000066	中国长城	6,600	125,730.00	0.07
270	300418	昆仑万维	3,100	125,116.00	0.07
271	002311	海大集团	2,800	124,908.00	0.07
272	688036	传音控股	2,109	124,325.55	0.07
273	600426	华鲁恒升	5,180	123,905.60	0.07
274	000625	长安汽车	17,236	123,582.12	0.07

275	600066	宇通客车	4,600	123,326.00	0.07
276	02331	李宁	9,500	121,458.03	0.07
277	01208	五矿资源	20,000	120,554.74	0.06
278	600436	片仔癀	1,100	120,208.00	0.06
279	00291	华润啤酒	6,500	120,137.84	0.06
280	600221	海航控股	88,900	120,015.00	0.06
281	000157	中联重科	17,200	119,884.00	0.06
282	605499	东鹏饮料	966	119,233.38	0.06
283	600895	张江高科	3,200	119,200.00	0.06
284	300803	指南针	1,300	119,171.00	0.06
285	002532	天山铝业	11,100	119,103.00	0.06
286	688506	百利天恒药业	400	117,612.00	0.06
287	00836	华润电力	8,000	117,566.93	0.06
288	03808	中国重汽	3,500	117,158.71	0.06
289	002340	格林美	17,700	116,997.00	0.06
290	000933	神火股份	5,500	116,600.00	0.06
291	02313	申洲国际	3,400	116,232.84	0.06
292	600011	华能国际	15,200	115,368.00	0.06
293	600048	保利发展	24,800	114,824.00	0.06
294	600438	通威股份	9,400	113,834.00	0.06
295	06990	科伦博泰生物	300	113,658.45	0.06
296	600570	恒生电子	5,340	113,154.60	0.06
297	601077	渝农商行	18,400	112,424.00	0.06
298	600115	中国东航	29,500	112,395.00	0.06
299	000783	长江证券	11,400	111,150.00	0.06
300	002493	荣盛石化	10,290	110,617.50	0.06
301	002236	大华股份	6,700	110,483.00	0.06
302	600886	国投电力	8,300	110,473.00	0.06
303	601555	东吴证券	13,790	109,216.80	0.06
304	603659	璞泰来	3,686	106,635.98	0.06
305	00019	太古股份公司 A	1,500	106,440.80	0.06
306	003816	中国广核	27,100	105,961.00	0.06
307	02688	新奥能源	3,000	105,424.60	0.06
308	000301	东方盛虹	9,200	105,340.00	0.06
309	601360	三六零	12,100	105,149.00	0.06
310	601058	赛轮轮胎	9,100	104,923.00	0.06
311	002736	国信证券	10,500	104,895.00	0.06
312	600026	中远海能	5,800	104,052.00	0.06
313	300339	润和软件	2,700	103,977.00	0.06
314	601901	方正证券	14,300	102,960.00	0.06

315	300759	康龙化成	3,550	102,701.50	0.06
316	01530	三生制药	7,000	102,688.67	0.06
317	002074	国轩高科	3,700	101,787.00	0.05
318	00135	昆仑能源	18,000	100,525.98	0.05
319	01928	金沙中国有限公司	8,800	99,744.28	0.05
320	01818	招金矿业	7,000	99,648.74	0.05
321	600009	上海机场	4,300	99,330.00	0.05
322	02268	药明合联	2,000	99,101.56	0.05
323	600196	复星医药	4,400	98,868.00	0.05
324	002595	豪迈科技	2,120	98,792.00	0.05
325	000975	山金国际	5,800	98,600.00	0.05
326	000768	中航西飞	4,800	98,304.00	0.05
327	601111	中国国航	16,100	97,405.00	0.05
328	002601	龙佰集团	5,900	97,232.00	0.05
329	601788	光大证券	6,700	96,681.00	0.05
330	601108	财通证券	11,170	96,620.50	0.05
331	600415	小商品城	9,500	96,520.00	0.05
332	600029	南方航空	18,600	96,348.00	0.05
333	301269	华大九天	800	95,536.00	0.05
334	601456	国联民生	10,800	95,472.00	0.05
335	600219	南山铝业	23,800	94,962.00	0.05
336	600674	川投能源	6,700	94,939.00	0.05
337	002128	电投能源	4,100	94,792.00	0.05
338	601186	中国铁建	15,900	94,605.00	0.05
339	600233	圆通速递	6,000	94,500.00	0.05
340	00270	粤海投资	14,000	94,359.27	0.05
341	601881	中国银河	7,500	94,275.00	0.05
342	601117	中国化学	12,700	93,345.00	0.05
343	601877	正泰电器	3,700	92,759.00	0.05
344	600372	中航机载	8,416	91,313.60	0.05
345	601878	浙商证券	9,600	91,200.00	0.05
346	002920	德赛西威	1,100	89,650.00	0.05
347	600839	四川长虹	12,800	89,344.00	0.05
348	01209	华润万象生活	2,800	89,203.56	0.05
349	301236	软通动力	2,100	89,145.00	0.05
350	600741	华域汽车	5,500	85,360.00	0.05
351	00966	中国太平	5,400	84,516.86	0.05
352	000963	华东医药	3,000	84,360.00	0.05
353	300866	安克创新	800	83,600.00	0.04
354	06862	海底捞	9,000	83,016.01	0.04
355	601021	春秋航空	1,800	82,044.00	0.04

356	000895	双汇发展	3,600	80,640.00	0.04
357	001979	招商蛇口	12,500	80,375.00	0.04
358	000661	长春高新	1,200	79,920.00	0.04
359	002653	海思科	1,200	79,608.00	0.04
360	002414	高德红外	5,981	79,308.06	0.04
361	00004	九龙仓集团	5,000	78,603.78	0.04
362	688728	格科微有限公司	3,727	78,416.08	0.04
363	601231	环旭电子	2,400	77,760.00	0.04
364	02618	京东物流	7,600	77,561.52	0.04
365	03888	金山软件	4,000	77,057.76	0.04
366	603606	东方电缆	1,840	76,378.40	0.04
367	002304	洋河股份	2,000	76,300.00	0.04
368	300919	中伟新材	1,740	76,125.00	0.04
369	601898	中煤能源	6,200	75,516.00	0.04
370	01972	太古地产	4,200	74,928.07	0.04
371	09863	零跑汽车	2,500	74,869.01	0.04
372	601319	中国人保	11,000	74,360.00	0.04
373	002078	太阳纸业	5,900	73,691.00	0.04
374	600023	浙能电力	14,000	73,640.00	0.04
375	00268	金蝶国际	14,000	71,985.42	0.04
376	600039	四川路桥	9,060	70,849.20	0.04
377	601800	中国交建	12,300	70,233.00	0.04
378	01929	周大福	7,400	70,057.24	0.04
379	000002	万 科 A	23,500	69,560.00	0.04
380	00241	阿里健康	26,000	69,553.48	0.04
381	002252	上海莱士	15,900	69,006.00	0.04
382	688187	时代电气	994	68,248.04	0.04
383	00322	康师傅控股	8,000	67,955.35	0.04
384	600600	青岛啤酒	1,300	67,899.00	0.04
385	688169	石头科技	710	67,428.70	0.04
386	688223	晶科能源	14,135	67,141.25	0.04
387	03998	波司登	18,000	66,913.09	0.04
388	09903	天数智芯	100	66,357.22	0.04
389	688599	天合光能	4,692	66,251.04	0.04
390	601633	长城汽车	4,300	64,887.00	0.03
391	00151	中国旺旺	22,000	64,776.46	0.03
392	002064	华峰化学	6,800	64,532.00	0.03
393	00144	招商局港口	6,000	64,307.44	0.03
394	600588	用友网络	7,000	64,260.00	0.03
395	302132	中航成飞	1,100	64,152.00	0.03
396	001965	招商公路	7,000	64,120.00	0.03
397	002294	信立泰	2,000	63,780.00	0.03

398	00285	比亚迪电子	3,500	63,595.23	0.03
399	000786	北新建材	3,500	63,315.00	0.03
400	300628	亿联网络	1,860	62,905.20	0.03
401	603260	合盛硅业	1,300	62,738.00	0.03
402	600027	华电国际	13,800	61,410.00	0.03
403	688188	上海柏楚电 子科技	574	61,245.80	0.03
404	601618	中国中冶	24,700	60,268.00	0.03
405	603806	福斯特	3,585	60,192.15	0.03
406	06181	老铺黄金	200	60,173.14	0.03
407	603369	今世缘	2,500	59,275.00	0.03
408	300832	新产业	1,400	58,800.00	0.03
409	601699	潞安环能	4,100	58,548.00	0.03
410	601607	上海医药	3,800	58,520.00	0.03
411	600642	申能股份	6,700	58,491.00	0.03
412	00780	同程旅行	5,600	58,317.92	0.03
413	600061	国投资本	8,900	58,295.00	0.03
414	000617	中油资本	8,800	57,992.00	0.03
415	600918	中泰证券	10,900	57,988.00	0.03
416	000983	山西焦煤	9,900	57,420.00	0.03
417	600025	华能水电	6,400	56,896.00	0.03
418	300251	光线传媒	5,100	56,559.00	0.03
419	02588	中银航空租 赁	800	56,455.75	0.03
420	00384	中国燃气	12,200	54,888.89	0.03
421	002459	晶澳科技	6,776	54,885.60	0.03
422	00960	龙湖集团	10,500	54,536.25	0.03
423	000958	电投产融	9,600	54,144.00	0.03
424	600515	海南机场	19,700	53,978.00	0.03
425	02259	紫金黄金国 际	700	53,806.67	0.03
426	601059	信达证券	3,300	53,427.00	0.03
427	600085	同仁堂	2,300	53,153.00	0.03
428	688472	阿特斯阳光 电力	4,898	52,996.36	0.03
429	00316	东方海外国 际	500	52,981.55	0.03
430	601216	君正集团	11,600	51,736.00	0.03
431	603195	公牛集团	1,308	51,208.20	0.03
432	02367	巨子生物	2,200	50,636.47	0.03
433	600803	新奥股份	3,200	50,560.00	0.03
434	600018	上港集团	10,500	49,560.00	0.03
435	000999	华润三九	2,202	49,522.98	0.03

436	000876	新 希 望	7,800	48,906.00	0.03
437	300999	金龙鱼	2,100	48,846.00	0.03
438	03311	中国建筑国际	8,000	48,430.35	0.03
439	600845	宝信软件	2,912	48,426.56	0.03
440	300122	智飞生物	4,100	47,929.00	0.03
441	000596	古井贡酒	600	47,880.00	0.03
442	002939	长城证券	5,700	47,538.00	0.03
443	01193	华润燃气	3,500	44,565.30	0.02
444	000708	中信特钢	3,500	44,170.00	0.02
445	300896	爱美客	500	43,600.00	0.02
446	688009	中国通号	8,978	42,735.28	0.02
447	06969	思摩尔国际	7,000	42,680.55	0.02
448	601018	宁波港	13,500	42,525.00	0.02
449	000987	越秀资本	5,286	41,336.52	0.02
450	09896	名创优品	2,000	40,960.82	0.02
451	000932	华菱钢铁	11,800	40,946.00	0.02
452	300765	石药创新	1,500	40,845.00	0.02
453	688303	大全能源	2,298	40,054.14	0.02
454	001280	中国铀业	600	40,020.00	0.02
455	02282	美高梅中国	4,400	38,751.23	0.02
456	601238	广汽集团	7,600	38,608.00	0.02
457	301165	锐捷网络	460	37,007.00	0.02
458	603392	万泰生物	1,360	36,679.20	0.02
459	300413	芒果超媒	2,500	36,575.00	0.02
460	01876	百威亚太	6,500	34,438.01	0.02
461	00293	国泰航空	3,000	33,821.34	0.02
462	601136	首创证券	2,000	27,900.00	0.02
463	300979	华利集团	800	23,800.00	0.01
464	600968	海油发展	7,000	23,310.00	0.01
465	301638	南网数字	900	21,645.00	0.01
466	601808	中海油服	2,000	21,620.00	0.01
467	601061	中信金属	2,000	21,540.00	0.01
468	001391	国货航	5,100	20,757.00	0.01
469	601298	青岛港	2,300	18,515.00	0.01
470	09973	奇瑞汽车	700	14,798.35	0.01
471	01364	古茗	800	14,688.92	0.01
472	301656	联合动力	800	13,784.00	0.01
473	002945	华林证券	1,000	13,430.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,233,766.00	0.46
2	00700	腾讯控股	618,482.78	0.23
3	688525	佰维存储	490,596.21	0.18
4	00005	汇丰控股	430,950.69	0.16
5	002353	杰瑞股份	340,348.00	0.13
6	002602	世纪华通	324,455.00	0.12
7	603986	兆易创新	280,786.00	0.10
8	600549	厦门钨业	269,885.00	0.10
9	000657	中钨高新	267,192.00	0.10
10	300476	胜宏科技	265,299.00	0.10
11	00001	长和	260,171.34	0.10
12	01088	中国神华	154,356.24	0.06
12	601088	中国神华	81,863.00	0.03
13	09988	阿里巴巴—W	219,444.10	0.08
14	01378	中国宏桥	215,119.35	0.08
15	00981	中芯国际	124,109.17	0.05
15	688981	中芯国际	82,559.46	0.03
16	00883	中国海洋石油	196,118.90	0.07
16	600938	中国海油	7,141.00	0.00
17	002837	英维克	193,498.00	0.07
18	000426	兴业银锡	193,033.00	0.07
19	02628	中国人寿	188,883.36	0.07
20	01299	友邦保险	176,478.82	0.07

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	5,735,139.67	2.13
2	09988	阿里巴巴—W	4,145,430.05	1.54
3	00005	汇丰控股	3,781,722.00	1.41
4	300750	宁德时代	1,696,668.00	0.63

4	03750	宁德时代	41,370.96	0.02
5	300308	中际旭创	1,548,034.00	0.58
6	00939	建设银行	1,468,019.94	0.55
6	601939	建设银行	4,220.00	0.00
7	01299	友邦保险	1,471,957.85	0.55
8	300502	新易盛	1,054,479.00	0.39
9	02888	渣打集团	1,006,465.16	0.37
10	01810	小米集团－W	959,783.50	0.36
11	01211	比亚迪股份	529,743.47	0.20
11	002594	比亚迪	409,034.00	0.15
12	03988	中国银行	897,068.68	0.33
12	601988	中国银行	3,025.00	0.00
13	01398	工商银行	834,922.20	0.31
13	601398	工商银行	9,144.00	0.00
14	00883	中国海洋石油	828,326.35	0.31
14	600938	中国海油	3,343.00	0.00
15	03690	美团－W	830,656.13	0.31
16	000333	美的集团	659,333.00	0.25
16	00300	美的集团	144,392.17	0.05
17	00388	香港交易所	774,868.85	0.29
18	00941	中国移动	719,774.70	0.27
19	02318	中国平安	671,369.42	0.25
19	601318	中国平安	16,035.00	0.01
20	00981	中芯国际	655,387.39	0.24

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,521,238.65
卖出股票收入（成交）总额	66,203,043.57

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,033,878.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	296,350.10
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,330,228.45
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
5,901	31,378.75	20,849,992.00	11.26	164,316,008.00	88.74

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 02 月 01 日) 基金份额总额	1,089,166,000.00
-----------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	265,166,000.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	80,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	185,166,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	35,318,493.42	42.69	7,744.58	44.19	
银河证券	5	25,314,943.32	30.60	5,333.79	30.44	
国信证券	2	12,795,748.14	15.47	2,527.26	14.42	
国泰海通	4	8,812,244.03	10.65	1,803.03	10.29	
方正证券	1	482,853.31	0.58	115.88	0.66	
长江证券	1	-	-	-	-	
东方证券	4	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国投证券	2	-	-	-	-	
华鑫证券	3	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
招商证券	4	-	-	-	-	

中金财富	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投 证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 2 个交易单元：国新证券（上交所单元，深交所单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 01 月 12 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所	2026 年 02 月 13 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所	2026 年 02 月 13 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 03 月 31 日
7	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 中证报	2026 年 04 月 01 日

	的公告		
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 04 月 22 日
9	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 05 月 06 日
11	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 中证报	2026 年 05 月 21 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报	2026 年 06 月 06 日
13	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 中证报	2026 年 06 月 29 日
14	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 中证报	2026 年 06 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

- 2、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日